



**AVERROES
CONCEPT**

365° SERVICES
für die Investment- & Risikokontrolle

365° Services ist das Dienstleistungspaket der Averroes Concept Lounge für Kapitalanlagegesellschaften, Asset Manager, Advisors, Depotbanken/Custodians und Versicherungen. Die Bausteine wurden für Risikokontroller entwickelt um ihre Werkzeuge zu schärfen, sie zu entlasten, Schadensfälle zu reduzieren und den Grad der Automatisierung zu erhöhen. Wir decken sämtliche Aspekte eines zuverlässigen, transparenten und flexiblen Risikokontrollprozesses ab. Dazu gehört nicht nur das Gesetz und die Umsetzung des Fonds- oder Verwaltungsvertrages in qualitativer und quantitativer Sicht, sondern auch die Standardisierung der Datenklassen, der IT-Prozesse und des Berichtswesens sowie die Schulung der fachlichen und mathematisch-stochastischen Anforderungen.

365° Services für die Investment- & Risiko

VERTRÄGE UND GESETZE IMPLEMENTIEREN

Die Umsetzung von Mandatsvorgaben in die ex-ante und die ex-post Prozesse innerhalb der UCITSIII/InvG Welt gehört zu unserem Alltagsgeschäft. Fordern Sie uns mit komplexen Anlagerestriktionen heraus. Wir bieten Ihnen die Erfahrung aus der Implementierung und Optimierung von über 8.000 institutionellen Portfolios und Publikumsfonds auf verschiedensten Plattformen.

STANDARDS ETABLIEREN

Unsere Berater etablieren Standards für Ihren Risikokontrollprozess. Die Standardisierung von Regelwerken, Abläufen, Schnittstellen und Kommunikationswegen ist unsere Stärke.

MANDATE EFFIZIENT ENTWERFEN

Unsere IT-Lösungen systematisieren die Mandatsauflegung. Ein effizienter Prozess führt direkt zur Umsetzung der Vertragsinhalte in die Risikokontroll- und Messsysteme. Einheitliche und transparente Kommunikationswege optimieren die Zusammenarbeit von Risikokontrolle, Vertrieb/Kundenbetreuung, Portfoliomanagement und Kunden.

RISIKEN MINIMIEREN

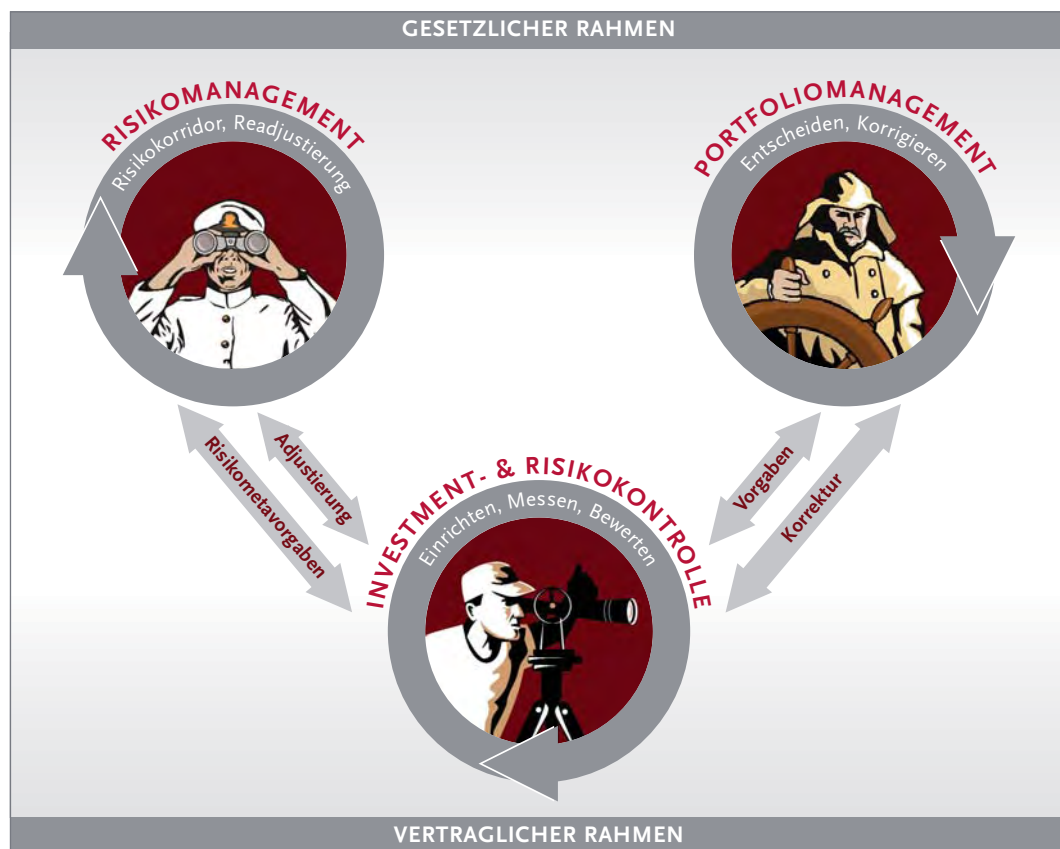
Durch die geschaffene Transparenz aller Prüfvorgänge erzielen wir eine Verminderung des Reputationsrisikos, gepaart mit einer Reduzierung von Schadensfällen.



kontrolle

UNSERE LEISTUNGEN IM ÜBERBLICK

- Implementierung der gesetzlichen und vertraglichen Anlagegrenzen in der ex-Ante und ex-Post Prüfung
- Fachliche und technische Integration der Risikokontrollsysteme in die Investmentprozesse
- Auswahl von Werkzeugen für die Risikokontrolle
- In-House Schulungen rund um UCITSIII/InvG/DerivateV
- Investment Compliance Health Check als Kurzprüfung der aktuellen Situation
- Lösungen für die Mandatsauflegung und Verwaltung der Anlagerestriktionen
- Unterstützung des Investment Compliance Fachbereichs im Tagesgeschäft
- Produktionsüberwachung und -steuerung sowie kontinuierliche Optimierung der Risikokontrolle



Leistungsangebot für die Investment- & Compliance

LEISTUNGEN FÜR DIE KERNPROZESSE DER INVESTMENTKONTROLLE

Implementierung von gesetzlichen Anlagegrenzen in der ex-Ante und ex-Post Prüfung

- Schaffung von Synergien bei der Implementierung und Pflege mehrerer Gesetzgebungen (insbesondere UCITSIII Länder)
- Komplette selbstständige, fachliche und technische Umsetzung

Implementierung von vertraglichen Anlagegrenzen in der ex-Ante und ex-Post Prüfung

- Interpretation der Mandatsverträge
- Beherrschung großer Mengen von Restriktionen durch die Anwendung von Metakzepten
- Entwurf und Umsetzung von Standards für die Investment Compliance Systeme
- Inhaltliche Strukturierung der verschiedenen Assetklassen
- Berücksichtigung der Spezifika der Asset Kategorien bei der Systemabbildung

Fachliche und technische Integration der Investment Compliance Systeme in die angrenzenden Prozesse

- Order Management
- Abwicklung
- Fondsbuchhaltung
- Depotbank
- Datenversorgung/DWH

Lösung von Informationsdefiziten in der ex-Ante Prüfung

- Homogene Implementierung im Dreieck - Portfolio Management, Investment Compliance und Daten Management
- Restriktive Prüfungskonzepte/Nutzung tariierter Standards

Integration quantitativer Systeme in das integrierte Risikokontrolling

- Integration der VAR-Systeme nach gesetzlichen Vorgaben
- Ergänzung um zusätzlich verfeinerte quantitative Kontrollmechanismen (Tail Modelling und weitere Verfahren)

FACHLICHE KOMPETENZEN UND EINGESETZTE WERKZEUGE

Länderspezifische Gesetzesrichtlinien

- D, LUX, CH, AT, IRL, GB, FR, IT, GR, USA, JP, TW

Themenspezifische Gesetzesrichtlinien

- InvG, DerivateV, VAG mit AnIV und Rundschreiben, GroMiKV, SpkVO, UCITSIII, Eligible Assets, US Inv. Comp. Act of 1940, Pensionskassenverordnung

Vertragliche Restriktionen

- Zuverlässigkeit und Selbstständigkeit bei der Interpretation und der Implementierung von gesetzlichen und vertraglichen Restriktionen
- Über 8.000 Mandate umgesetzt für mehr als 30 Kunden
- Reduktion der Fehlerraten in der Prüfung
- Einsatz in Teams oder als Individualisten, je nach Wunsch

Expertise

- Umfassende Kenntnisse der Werkzeuge, Datenstrukturen und Schnittstellen
- Effiziente und hochwertige Umsetzung
- Intensives Coaching unserer Kunden und Wissenstransfer

Investment Compliance

- Aquin MIG 21, Charles River Compliance, Bloomberg POMS, SUNGARD Systeme (V3, Decalog, GP3), Allocare AMS

Fondsbuchhaltung

- SimCorp Dimension, Xentis, V3 Fonds, Multifonds, GP

Quantitative Risikokontrolle

- RiskMetrics, Allocare VAR Approach, Algorithmics

Portfolio- und Ordermanagement

- SimCorp Dimension, Aquin ORS, Charles River, Allocare AMS, TripleA

Investment- & Compliance



Risikokontrolle: Wissen & Werkzeuge

BERATUNGSANGEBOT RUND UM DIE INVESTMENTKONTROLLE

Auswahl von Standardsoftware

- Anforderungsanalyse
- Konzeption und Durchführung von Ausschreibungen
- Befragung der Anbieter sowie Auswertung
- Ausarbeitung der Entscheidungsvorlage

In-House Schulungen

- Risikomanagement für Asset Manager, Versicherungen
- Deutsche und Luxemburger Investmentgesetzgebung
- Schulung von Investment Compliance Standardsoftware

Lösungen für die Mandatsauflegung und Verwaltung der Anlagerestriktionen

- Strukturierung der Prozesse zur Mandatsauflegung und Aufnahme neuer Kunden
- Transparenz und Revisionsicherheit für aktuelle und historische Vertragsbedingungen
- Auf Wunsch kommen auch unsere IT Lösungen für Master KAGs, Publikums- und Spezialfonds, Asset Managementmandate und das Advisory zum Einsatz
- Kalkulation für die Mandatsaufnahme mittels Verwendung von Standards und Abweichungen

Health Check

- Abdeckung gesetzlicher und vertraglicher Restriktionen
- Systematik der Regeln und Assetklassen
- Abläufe in der Mandatsauflegung und im NPP
- Organisation der Produktionsprozesse
- Informationsflüsse zwischen den Abteilungen und Systemen
- Adäquanz der Organisationsstrukturen
- Vorbereitung der Prüfung durch Wirtschaftsprüfer und Revision
- Prüfung des Bafin Meldewesens

ANGEBOT FÜR DIE OPERATIVE UNTERSTÜTZUNG

Unterstützung des Fachbereichs im Tagesgeschäft

- Analyse von Verletzungen in der Prüfung, Klärung der Ursachen mit dem Portfoliomanagement und dem Back-Office
- 1st Level Support für das Portfolio Management in der ex-Ante Prüfung
- Analyse von neuen oder geänderten Anlagerestriktionen, Ableitung der Regelwerke

Produktionsüberwachung der Risikokontrollsysteme

- Überwachung und Steuerung der Produktionsprozesse, -systeme und der Schnittstellen
- Analyse von Unschärfen und Fehlersituationen in der Datenversorgung und Einleitung von Gegenmaßnahmen
- Präventive Überwachung der Prüfergebnisse und Unterstützung des Fachbereichs bei der Analyse von Prüfergebnissen, speziell bei Datenfehlern
- Bearbeiten von Benutzeranfragen aller Art zu Daten, System, Prozess und Zusammenspiel um Ursachen für Anomalien zu identifizieren
- Kontinuierliche Optimierung der Produktionsprozesse zur Reduzierung von Fehlerraten

Management und Organisation von Veränderungen

- Organisation von neuen Assetklassen und deren Einsatz
- Umsetzung neuer Rundschreiben und Regelungen
- Umsetzung von Gesetzesnovellen
- Etablierung neuer Datenquellen und -strukturen
- Umsetzung geänderter oder spezieller Kundenservices

ÜBER AVERROES CONCEPT LOUNGE

Averroes Concept Lounge ist ein innovativer Berater und Lösungsanbieter für die Investment- und Risikokontrolle und Unternehmensanalyse. Die Kunden von Averroes Concept Lounge sind Asset Manager und Research-Häuser. Als Berater und IT-Ingenieure mit hoher Innovationskraft schaffen wir effiziente und transparente Prozesse für unsere Kunden.

Für weitere Informationen über unser Unternehmen, unsere Lösungen und unsere Beratungsleistungen kontaktieren Sie bitte 365GRAD@averroesconcept.de oder besuchen Sie unsere Website www.averroesconcept.de/365GRAD.

KONTAKT

Standort Frankfurt

Clemensstrasse 8
60487 Frankfurt am Main
Tel. +49 (0)69 48 44 44 42
Fax +49 (0)69 48 44 44 43

Standort Freiburg

Zasiusstrasse 55
79102 Freiburg
Tel. +49 (0)761 76 99 88 994